

浙江盾安人工环境股份有限公司

关于开展商品期货套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

浙江盾安人工环境股份有限公司（以下简称“公司”）于2022年8月23日召开第八届董事会第三次会议、第八届监事会第三次会议审议通过了《关于开展商品期货套期保值业务的议案》，自公司董事会审议通过之日起12个月继续开展铜、锌、铝和镍等商品期货套期保值业务。本次套期保值业务在董事会审批权限内，无需提交股东大会审议批准。具体内容公告如下：

一、开展套期保值业务的目的

大宗原材料铜、锌、铝、镍等是公司产品生产所需的主要原材料，其价格波动会对公司生产经营产生较大影响。公司开展铜、锌、铝和镍等商品期货套期保值业务，目的是充分利用期货市场的套期保值功能，通过买入(卖出)与现货市场数量相当、交易方向相反的期货合约，规避和减少因其价格波动引起所带来的经营风险。开展商品期货套期保值业务不会影响公司主营业务的发展。

二、预计开展的套期保值业务基本情况

1、套期保值的期货品种：

仅限于与公司生产经营相关的主要原材料，且为境内外期货交易所挂牌交易的铜、锌、铝和镍等商品期货交易合约。

2、业务开展期间：

自公司董事会审议通过之日起12个月。

3、预计投入资金额度：

公司根据公司产能规模、主要客户市场需求，拟进行铜、锌、铝和镍等买入期货套期保值操作，同时对库存铜、锌、铝和镍进行卖出套期保值操作。预计投入自有保证金合计最高额度不超过5,000万元，额度范围内资金可循环使用。

4、资金来源

公司自有资金。

5、合约期限

不超过12个月。

6、业务授权

公司董事会授权公司经营层在上述额度范围内具体实施上述套期保值业务相关事宜。

7、实施主体

公司或公司下属子公司。

三、期货套期保值业务的可行性分析

铜、锌、铝和镍等期货品种在国际国内都是成熟品种，套期保值也是行业控制价格风险的通行做法。因此通过开展期货的套期保值业务规避价格波动风险是切实可行的，公司根据客户及公司生产经营需要进行铜、锌、铝和镍等商品期货套期保值，可以控制原材料采购成本，规避经营中的原材料价格波动风险，对生产经营是有利的。

公司已建立了较为完善的商品期货套期保值业务内部控制和 risk 管理制度，具有与拟开展的期货套期保值业务交易保证金相匹配的自有资金，并按照《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第1号——主板上市公司规范运作》等法律法规和公司《商品期货套期保值业务管理制度》的要求，成立期货领导小组作为管理公司期货套期保值业务的领导机构，落实风险防范措施，审慎操作。

四、套期保值风险分析

公司进行商品期货套期保值业务是以规避经营原材料价格波动风险为目的，不做投机性、单纯套利性交易操作，在签订套期保值合约及开平仓时进行严格的风险控制，但期货市场仍存在一定的风险：

1、市场风险：不确定突发事件可能会发生期货价格与现货价格走势背离或市场大幅波动，而造成公司被迫平仓产生较大损失或无法通过交割现货实现盈利；

2、流动性风险：（1）市场流动性风险。由于市场交易不活跃或市场中断，无法按现行市价价格或与之相近的价格平仓所产生的风险；（2）现金流动性风险。期货套期保值交易采取保证金制度及逐日盯市制度，存在资金流动性风险及因保证金不足、追加不及时被强平的风险；

3、信用风险：在产品交付周期内，由于商品期货价格大幅波动，客户主动

违约而造成公司期货交易上的损失；

4、操作风险：由于期货交易专业性较强，复杂程度较高，存在因信息系统或内部控制方面的缺陷而导致意外损失的可能；

5、技术风险：由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成交易系统非正常运行，导致交易指令延迟、中断或数据错误等问题；

6、法律风险：因相关法律、法规发生重大变化可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。如果公司选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为，也可能给公司带来损失。

五、套期保值内部控制措施

1、公司制定了《商品期货套期保值业务管理制度》，严格规定了该业务的操作程序，同时加强对相关执行人员的职业道德及业务培训，避免操作风险，建立异常情况报告机制，形成高效的风险处理程序。

2、公司成立期货套期保值业务领导小组作为公司期货业务的管理机构，总裁为期货小组负责人，在董事会、股东大会授权范围内负责指令的下达和监督执行，财务部门具体进行业务操作，供应链管理部门、营销管理部门配合工作，内控部门对交易执行情况进行审计与监督。

3、公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，严格控制套期保值的资金规模，在市场价格剧烈波动时及时平仓以规避风险。

4、根据《深圳证券交易所股票上市规则》（2022年修订）、《上市公司自律监管指引第1号——主板上市公司规范运作》及《上市公司自律监管指引第7号——交易与关联交易》等有关规定，保证本次套期保值业务以公司或下属子公司的名义设立套期保值交易账户，严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，不使用募集资金直接或间接进行套期保值。

六、投资对公司的影响

公司套期保值业务投入的保证金规模与自有资金、经营情况和实际需求相匹配，不会影响主营业务的正常开展，也不会对公司财务及经营状况产生重大不利影响。

公司套期保值业务的相关会计政策及核算原则将严格按照财政部发布的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第24号——套期会计》、《企业会计准则第37号——金融工具列报》等相关规定执行，对开展的套期保值业

务进行相应的核算处理。

七、独立董事意见

1、公司商品期货套期保值业务的相关审批程序符合相关法律、法规及《公司章程》的有关规定。

2、公司已就商品期货套期保值业务的行为建立了健全的组织机构、业务操作流程、审批流程及《商品期货套期保值业务管理制度》。

3、在保证正常生产经营的前提下，公司开展套期保值业务，有利于锁定公司的产品预期利润，控制经营风险，提高公司抵御价格波动的能力，不存在损害公司和全体股东利益的情形。

综上，我们一致同意《关于开展商品期货套期保值业务的议案》的内容。

八、备查文件

- 1、浙江盾安人工环境股份有限公司第八届董事会第三次会议决议。
- 2、浙江盾安人工环境股份有限公司第八届监事会第三次会议决议。
- 3、浙江盾安人工环境股份有限公司独立董事关于第八届董事会第三次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

浙江盾安人工环境股份有限公司

董 事 会

二〇二二年八月二十四日